

Finančné deriváty, letný semester 2017/2018

Bonusová úloha 1

- Môžete kupovať a predávať opcie na akcie Amazonu uvedené na nasledujúcej strane (nie samotné akcie). Všetky opcie sú call opcie a ich expirácia je 20. apríla 2018. Kupovať a predávať môžete ľubovoľný celočíselný počet opcií.
- Zostavte stratégiu, ktorá zohľadňuje vaše očakávanie o vývoji ceny akcie. Jedinou požiadavkou na stratégiu je, v že vaša strata nemôže byť väčšia ako 100 USD, bez ohľadu na cenu akcie v čase expirácie opcií.
- Úlohu môžete vypracovať samostatne alebo v skupinách, maximálne trojiciach. Stratégie budú po termíne odovzdania zverejnené.
- Odovzdáva sa:
 - slovný popis stratégie (koľko akých opcií kupujete)
 - skript pre R-ko, v ktorom je definovaná funkcia tvaru **vase.meno.alebo.nick(S)** vracajúca váš profit ako funkciu ceny akcie a ktorý kreslí profit diagram vašej stratégie
 - výsledný profit diagram ako obrázok
 - meno, resp. mená ľudí v skupine
- Odovzdávanie: mailom na adresu beata.ulohy@gmail.com do **štvrtku 8. 3. 2018** s predmetom **FD 2018 - bonus 1 – nick** (nick vašej skupiny, pod ktorým bude stratégia zverejnená v zozname)
- Hodnotenie:
 - 1 bod za stratégiu spĺňajúcu uvedenú podmienku;
 - + 1 bod, ak bude vaša stratégia v čase expirácie zisková;
 - + ďalšie 3 body pre stratégiu, ktorá dosiahne najvyšší zisk (za predpokladu, že niektorá stratégia zisk dosiahne) .

Ak úlohu riešite v skupine, tieto body dostáva každý člen skupiny. V prípade, že najvyšší zisk dosiahne niekoľko stratégií, uvedené 3 bonusové body sa rozdelia medzi ne (napríklad ak tri skupiny dosiahnu rovnaký najvyšší zisk, každý člen týchto skupín získa $3/3 = 1$ bod).

April 20, 2018 ▼

In The Money

Show: [List](#) | [Straddle](#)

Calls for April 20, 2018

Contract Name	Last Trade Date	Strike	Last Price	Bid	Ask	Change	% Change
AMZN180420C01430000	2018-02-22 9:35AM EST	1,430.00	111.00	104.35	108.20	+4.40	+4.13%
AMZN180420C01440000	2018-02-22 9:59AM EST	1,440.00	98.65	99.75	102.80	+1.35	+1.39%
AMZN180420C01450000	2018-02-22 9:59AM EST	1,450.00	92.00	92.85	96.45	+1.90	+2.11%
AMZN180420C01460000	2018-02-22 10:00AM EST	1,460.00	86.57	87.55	90.30	+0.52	+0.60%
AMZN180420C01470000	2018-02-22 10:00AM EST	1,470.00	80.75	80.40	83.35	-0.25	-0.31%
AMZN180420C01480000	2018-02-22 10:00AM EST	1,480.00	75.20	76.70	79.45	+1.85	+2.52%
AMZN180420C01490000	2018-02-22 9:59AM EST	1,490.00	70.25	71.75	74.20	+1.51	+2.20%
AMZN180420C01500000	2018-02-22 10:02AM EST	1,500.00	66.27	64.80	67.25	+2.52	+3.95%
AMZN180420C01510000	2018-02-22 9:54AM EST	1,510.00	62.00	61.60	63.50	+2.00	+3.33%
AMZN180420C01520000	2018-02-22 9:59AM EST	1,520.00	56.04	56.60	59.05	+0.33	+0.59%
AMZN180420C01530000	2018-02-22 9:49AM EST	1,530.00	56.65	52.30	54.55	+4.15	+7.90%
AMZN180420C01540000	2018-02-22 10:00AM EST	1,540.00	47.80	47.15	48.95	-0.10	-0.21%
AMZN180420C01550000	2018-02-22 10:00AM EST	1,550.00	43.50	43.75	46.25	+0.80	+1.87%
AMZN180420C01560000	2018-02-22 9:51AM EST	1,560.00	42.68	40.80	42.50	+1.70	+4.15%